

Sijoitukset riskin mukaisesti ryhmiteltynä 31.12.2017 1)

31.12.2017	Perusjakauma		Riskijakauma		MWR -tuotto 2)	Volatiliteetti 3)
	MEUR	%	MEUR	%	%	%
Korkosijoitukset	8 377,4	42,8 %	7 686,9	39,2 %	2,0 %	
Lainasaamiset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Joukkovelkakirjalainat	6 392,3	32,6 %	5 701,7	29,1 %	2,8 %	2,1 %
Julkisyhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 204,3	16,4 %	2 535,4	12,9 %	2,9 %	
Muiden yhteisöjen joukkovelkakirjalainat	3 188,0	16,3 %	3 166,3	16,2 %	2,7 %	
Muut rahoitusmarkkinavälineet ja talletukset	1 985,1	10,1 %	1 985,1	10,1 %	-0,2 %	
Osakesijoitukset	9 454,5	48,3 %	9 522,0	48,6 %	11,4 %	
Noteeratut osakkeet	8 509,0	43,4 %	8 576,5	43,8 %	11,0 %	7,7 %
Pääomasijoitukset	827,7	4,2 %	827,7	4,2 %	13,2 %	
Noteeraamattomat osakkeet	117,8	0,6 %	117,8	0,6 %	23,6 %	
Kiinteistösijoitukset	836,7	4,3 %	836,7	4,3 %	7,4 %	
Suorat kiinteistösijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Kiinteistösijoitusrahastot ja yhteissijoitusyritykset	836,7	4,3 %	836,7	4,3 %	7,4 %	
Muut sijoitukset	917,5	4,7 %	1 012,6	5,2 %	4,1 %	
Hedge-rahastosijoitukset	712,0	3,6 %	712,0	3,6 %	4,8 %	2,2 %
Hyödykesijoitukset	0,0	0,0 %	0,0	0,0 %	0,0 %	
Muut sijoitukset	205,5	1,0 %	300,6	1,5 %	1,4 %	
Sijoitukset yhteensä	19 586,2	100,0 %	19 058,2	97,3 %	6,6 %	3,2 %
Johdannaisten vaikutus			528,0	2,7 %		
Sijoitukset käyvin arvoin yhteensä	19 586,2	100,0 %	19 586,2	100,0 %		
Jvk-salkun modifioitu duraatio	3,7 vuotta					
Avoin valuuttapositio on	21,9 % sijoitusten arvosta					

1) Sisältää siirtyvät korot

2) Kokonaistuotto sisältää kohdistamattomia kuluja/tuottoja

3) Sijoitusten volatiliteetti laskettu kuukausihavainnoista 24 kk:n ajanjaksolta.